
东方红纯债债券型发起式证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

上海东方证券资产管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 7 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 8 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 9 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 9 |
| 3.2 基金净值表现..... | 9 |
| §4 管理人报告 | 12 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 12 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 16 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 16 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 16 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 17 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 17 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 18 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 18 |
| §5 托管人报告 | 19 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 19 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 19 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 19 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 20 |
| 6.1 资产负债表..... | 20 |
| 6.2 利润表..... | 21 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 23 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 25 |
| §7 投资组合报告..... | 50 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 50 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 50 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 50 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 50 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 51 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 51 |
| 金额单位：人民币元..... | 51 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 51 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 52 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细..... | 52 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 52 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 52 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 54 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 54 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 54 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 54 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况..... | 54 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 56 |
| §10 重大事件揭示..... | 57 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 57 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 57 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 57 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 57 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 57 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 57 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 57 |
| 10.8 其他重大事件..... | 58 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 60 |

| | |
|--|-----------|
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 60 |
| §12 备查文件目录..... | 61 |
| 12.1 备查文件目录..... | 61 |
| 12.2 存放地点..... | 61 |
| 12.3 查阅方式..... | 61 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------|
| 基金名称 | 东方红纯债债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称 | 东方红纯债债券 |
| 基金主代码 | 001906 |
| 前端交易代码 | 001906 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式、发起式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 10 月 26 日 |
| 基金管理人 | 上海东方证券资产管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 60,143,593.77 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金为纯债基金，主要通过分析影响债券市场的各类要素，对债券组合的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置，追求长期稳定的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将采用自上而下的方法，在充分研究基本宏观经济形势以及微观市场主体的基础上，对市场基本利率、债券类产品收益率、货币类产品收益率等大类产品收益率水平变化进行评估，并结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，针对不同行业、不同投资品种选择投资策略，以此做出最佳的资产配置及风险控制。 |
| 业绩比较基准 | 同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款税后收益率+1.2%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风 |

| | |
|--|---|
| | 险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金， 低于混合型基金和股票型基金。 |
|--|---|

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|-------------------------------|--------------------------|
| 名称 | | 上海东方证券资产管理有 限公司 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 唐涵颖 | 张燕 |
| | 联系电话 | 021-63325888 | 0755-83199084 |
| | 电子邮箱 | service@dfham.com | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | 4009200808 | 95555 |
| 传真 | | 021-63326981 | 0755-83195201 |
| 注册地址 | | 上海市黄浦区中山南路 318 号 31 层 | 深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦 |
| 办公地址 | | 上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 31 层 | 深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦 |
| 邮政编码 | | 200010 | 518040 |
| 法定代表人 | | 陈光明 | 李建红 |

2.4 信息披露方式

| | |
|--------------------------|--|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网 网址 | www.dfham.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海东方证券资产管理有限公司 上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道 7088 号招 商银行大厦 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------|--------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 中国北京市西城区太平桥大街 17 号 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | -6,451,597.69 |
| 本期利润 | 3,710,788.25 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0329 |
| 本期加权平均净值利润率 | 3.31% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.92% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | -2,146,908.51 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0357 |
| 期末基金资产净值 | 60,540,054.07 |
| 期末基金份额净值 | 1.007 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2017年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 3.95% |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、表中的“期末”均指报告期最后一日，即2017年6月30日；“本期”指2017年1月1日 - 2017年6月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 0.60% | 0.05% | 0.22% | 0.01% | 0.38% | 0.04% |
| 过去三个月 | 0.60% | 0.07% | 0.67% | 0.01% | -0.07% | 0.06% |
| 过去六个月 | 1.92% | 0.09% | 1.34% | 0.01% | 0.58% | 0.08% |
| 过去一年 | 2.10% | 0.09% | 2.70% | 0.01% | -0.60% | 0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.95% | 0.08% | 4.54% | 0.01% | -0.59% | 0.07% |

注：1、自基金合同生效日起至至今指 2015 年 10 月 26 日-2017 年 6 月 30 日。

2、根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款税后收益率+1.2%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，t 日收益率 ($benchmark_t$) 按下列公式计算：

$$benchmark_t = 100\% * [(t \text{ 日同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款税后收益率} + 1.2\%) / 365]$$

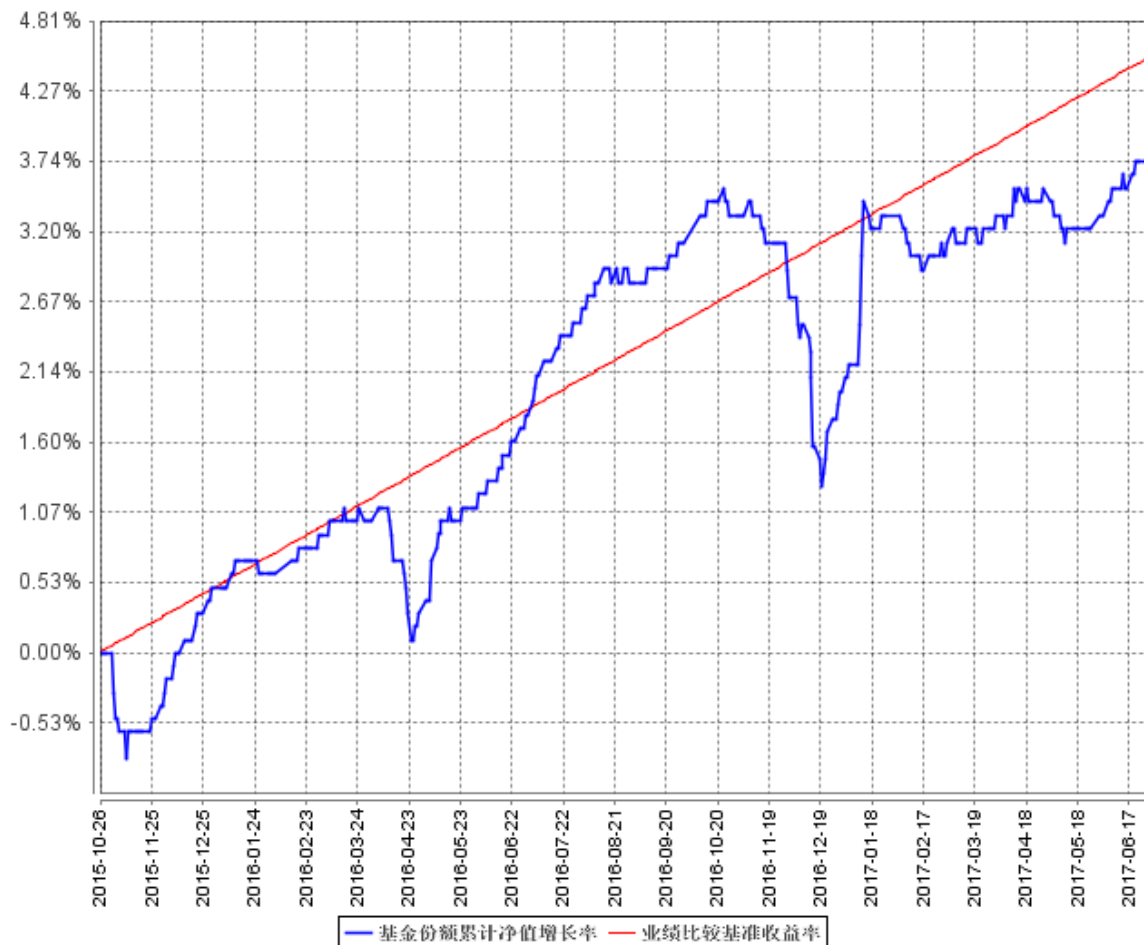
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ，T 表示时间截至日；

t 日至 T 日的期间收益率 ($benchmark_t^T$) 按下列公式计算：

$$benchmark_t^T = \sum_{t=1}^T benchmark_t$$

其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\sum_{t=1}^T benchmark_t$ 表示 t 日至 T 日的 $benchmark_t$ 数学连加。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2017 年 6 月 30 日。

2、本基金建仓期 6 个月，即从 2015 年 10 月 26 日起至 2016 年 4 月 25 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日,是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》(证监许可[2010]518 号)批准,由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月,公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至 2017 年 6 月 30 日,本基金管理人共管理东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红纯债债券型发起式证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金二十七只证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------------|------------------|------|--------|------------------------------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 纪文静 | 上海东方证券资产管理 | 2015 年 10 月 26 日 | - | 10 年 | 硕士,曾任东海证券股份有限公司固定收益部投资研究经理、销售交易经理, |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | <p>理有限公司公募固定收益投资部副 总经理、 兼任东方红领先精选混合型证券投资 基金、 东方红稳健精选混合型证券投资基 金、东方 红睿逸 定期开 放混合 型发起 式证券 投资基 金、东方 红策略 精选灵 活配置 混合型</p> | | | <p>德邦证券股份有限公司债券投资与交易部总经理， 上海东方证券资产管理有 限公司固定收益部副总 监；现任上海东方证券资 产管理有限公司公募固定 收益投资部副总经理兼任 东方红领先精选混合、东 方红稳健精选混合、东方 红睿逸定期开放混合、东 方红策略精选混合、东方 红纯债债券、东方红收益 增强债券、东方红信用债 债券、东方红汇阳债券、 东方红汇利债券、东方红 稳添利纯债、东方红战略 精选混合、东方红价值精 选混合、东方红益鑫纯债 债券、东方红智逸沪港深 定开混合基金经理。具有 基金从业资格，中国国籍。</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|--|
| | 发起式 证券投 资基金、 东方红 纯债债 券型发 起式证 券投资 基金、东 方红收 益增强 债券型 证券投 资基金、 东方红 信用债 债券型 证券投 资基金、 东方红 汇阳债 券型证 券投资 基金、东 方红汇 利债券 型证券 投资基 金、东方 | | | | |
|--|---|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|--|
| | 红稳添 利纯债 债券型 发起式 证券投 资基金、 东方红 战略精 选沪港 深混合 型证券 投资基 金、东方 红价值 精选混 合型证 券投资 基金、东 方红益 鑫纯债 债券型 证券投 资基金、 东方红 智逸沪 港深定 期开放 混合型 发起式 | | | | |
|--|---|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|-------------------------|--|--|--|--|
| | 证券投资 基金 基金经 理。 | | | | |
|--|-------------------------|--|--|--|--|

注：1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对此后非首任基金经理，基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年受基本面数据强劲、货币政策收紧以及金融监管等因素影响，债券市场出现了大幅下跌，10 年期国债收益率从年初 3.1% 最高上升至 3.7% 附近，信用债也出现了 100BP 以上幅度的调整。而 5 月中下旬开始，随着监管基调的缓和、央行加大公开市场操作改善流动性预期以及美联储 6 月鸽派加息后央行未跟随上调公开市场操作利率等因素影响，债券收益率高位企稳并有所回落。上半年中债总财富指数下跌 0.5%。本基金在债券配置上适时调仓，控制久期和杠杆，寻求稳健配置为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.007 元，份额累计净值为 1.039 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 1.92%，同期业绩比较基准收益率为 1.34 %。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年上半年宏观经济呈现相对稳定的格局。上半年整体投资增速虽然未能延续去年的复苏趋势，但也未出现明显下行，整体仍然呈现企稳的格局，好于市场预期。展望下半年，考虑到美国及欧洲经济持续好转，不排除国内经济出现继续超预期的情况。

从债券市场来看，金融监管以及货币政策边际再收紧概率降低都将使市场面临的环境较上半年有所好转，但经济回落幅度短期内或不及预期、海外数据好转也带来货币政策的转向，都将导致短期内市场仍维持震荡走势。下半年操作上，我们将精选个券，以获取稳定的票息收入为主，同时关注市场波动带来的机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。同时，公司设估值决策小组，成员包括：公司总经理、合规总监（督察长）、交易总监、运营总监、基金会计主管等。基金经理不参与基金日常估值业务，对于属于东证资管估值政策范围内的特殊估值变更可参与讨论，但最终

决策由估值决策小组讨论决策并联名审批。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署提供中债收益率曲线和中债估值的服务协议，由其按约定提供银行间同业市场债券品种的估值数据。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 3、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金本报告期末进行利润分配。

本基金将严格按法律规定及基金合同约定进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方红纯债债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 445,714.92 | 61,408,399.42 |
| 结算备付金 | | 256,734.18 | - |
| 存出保证金 | | 32,468.34 | 1,015.98 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 55,910,200.00 | 919,309,651.06 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 55,910,200.00 | 755,871,300.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | 163,438,351.06 |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 3,000,000.00 | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 1,004,379.64 | 16,525,177.72 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 60,649,497.08 | 997,244,244.18 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |

| | | | |
|---------------|----------|---------------|------------------|
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 14,880.27 | 253,537.26 |
| 应付托管费 | | 4,960.09 | 84,512.43 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 342.50 | 2,875.00 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 89,260.15 | 200,000.00 |
| 负债合计 | | 109,443.01 | 540,924.69 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 60,143,593.77 | 1,009,029,692.76 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 396,460.30 | -12,326,373.27 |
| 所有者权益合计 | | 60,540,054.07 | 996,703,319.49 |
| 负债和所有者权益总计 | | 60,649,497.08 | 997,244,244.18 |

注：1、本基金合同生效日为 2015 年 10 月 26 日。2、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.007 元，基金份额总额 60,143,593.77 份。

6.2 利润表

会计主体：东方红纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 4,061,762.99 | 14,356,965.26 |
| 1.利息收入 | | 2,219,115.57 | 19,106,802.25 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 167,312.94 | 191,731.33 |
| 债券利息收入 | | 1,764,823.23 | 13,267,884.75 |
| 资产支持证券利息收入 | | 279,523.28 | 4,355,109.42 |
| 买入返售金融资产收入 | | 7,456.12 | 1,292,076.75 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -8,319,738.58 | -1,572,043.50 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -8,582,324.25 | -1,495,768.74 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | 262,585.67 | -76,274.76 |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 10,162,385.94 | -3,178,594.00 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 0.06 | 800.51 |
| 减：二、费用 | | 350,974.74 | 1,980,669.01 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 172,980.02 | 1,379,610.59 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 57,660.04 | 459,870.14 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 5,748.97 | 4,445.59 |
| 5. 利息支出 | | 4,448.94 | 16,570.89 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 4,448.94 | 16,570.89 |

| | | | |
|---------------------|----------|--------------|---------------|
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 110,136.77 | 120,171.80 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 3,710,788.25 | 12,376,296.25 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 3,710,788.25 | 12,376,296.25 |

注：本基金合同生效日为 2015 年 10 月 26 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | | |
|-----------------------------------|---------------------------------|----------------|-----------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,009,029,692.76 | -12,326,373.27 | 996,703,319.49 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 3,710,788.25 | 3,710,788.25 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -948,886,098.99 | 9,012,045.32 | -939,874,053.67 |
| 其中：1.基金申购款 | 49,999,000.00 | - | 49,999,000.00 |
| 2.基金赎回款 | -998,885,098.99 | 9,012,045.32 | -989,873,053.67 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基 | - | - | - |

| | | | |
|--|---------------------------------|---------------|------------------|
| 金净值变动（净值减少以“-”号填列） | | | |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 60,143,593.77 | 396,460.30 | 60,540,054.07 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | |
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 512,066,741.88 | 2,468,106.58 | 514,534,848.46 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 12,376,296.25 | 12,376,296.25 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 496,994,436.09 | 2,982,780.78 | 499,977,216.87 |
| 其中：1.基金申购款 | 497,066,010.81 | 2,982,641.62 | 500,048,652.43 |
| 2.基金赎回款 | -71,574.72 | 139.16 | -71,435.56 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | -7,063,776.18 | -7,063,776.18 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 1,009,061,177.97 | 10,763,407.43 | 1,019,824,585.40 |

注：本基金合同生效日为 2015 年 10 月 26 日。报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈光明
基金管理人负责人

任莉
主管会计工作负责人

詹朋
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方红纯债债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予东方红纯债债券型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]2168 号文)准予注册,由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2015 年 10 月 26 日生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限不定期。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金于 2015 年 10 月 19 日至 2015 年 10 月 20 日向社会公开募集,扣除认购费后的有效认购资金 210,217,687.88 元,利息结转份额 9,462.85 元,募集规模为 210,227,150.73 份。上述募集资金已由立信会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、中小企业私募债、证券公司发行的短期公司债券、分离交易可转债的纯债部分、债券逆回购、银行存款等固定收益类资产、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不参与股票、权证等权益类资产的投资,可转债仅投资可分离交易可转债的纯债部分。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。本基金各类资产的投比例范围为:投资债券的比例不低于基金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款税后收益率+1.2%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资

基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1

日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----------------|-----------------|
| | 2017 年 6 月 30 日 |
| 活期存款 | 445,714.92 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 445,714.92 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | | |
|-----------|-----------------|------|--------|
| | 2017 年 6 月 30 日 | | |
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所 | - | - | - |

| | | | | |
|--------|-------|---------------|---------------|-------------|
| 黄金合约 | | | | |
| 债券 | 交易所市场 | 54,087,500.50 | 53,843,700.00 | -243,800.50 |
| | 银行间市场 | 2,076,459.18 | 2,066,500.00 | -9,959.18 |
| | 合计 | 56,163,959.68 | 55,910,200.00 | -253,759.68 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 56,163,959.68 | 55,910,200.00 | -253,759.68 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 | |
|--------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券 | 3,000,000.00 | - |
| 合计 | 3,000,000.00 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|----------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 196.55 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |

| | |
|------------|--------------|
| 应收结算备付金利息 | 115.50 |
| 应收债券利息 | 998,594.46 |
| 应收买入返售证券利息 | 458.63 |
| 应收申购款利息 | 4,999.90 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 14.60 |
| 合计 | 1,004,379.64 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他应收款、待摊费用等其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 342.50 |
| 合计 | 342.50 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 预提费用 | 89,260.15 |
| 合计 | 89,260.15 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,009,029,692.76 | 1,009,029,692.76 |
| 本期申购 | 49,999,000.00 | 49,999,000.00 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -998,885,098.99 | -998,885,098.99 |
| 本期末 | 60,143,593.77 | 60,143,593.77 |

注：申购份额含红利再投份额（本基金暂未开通基金转换业务）。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 1,739,835.97 | -14,066,209.24 | -12,326,373.27 |
| 本期利润 | -6,451,597.69 | 10,162,385.94 | 3,710,788.25 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,564,853.21 | 6,447,192.11 | 9,012,045.32 |
| 其中：基金申购款 | -1,431,276.22 | 1,431,276.22 | - |
| 基金赎回款 | 3,996,129.43 | 5,015,915.89 | 9,012,045.32 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -2,146,908.51 | 2,543,368.81 | 396,460.30 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| | 活期存款利息收入 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |

| | |
|-----------|------------|
| 结算备付金利息收入 | 3,063.88 |
| 其他 | 5,229.84 |
| 合计 | 167,312.94 |

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金不参与股票投资。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -8,582,324.25 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | -8,582,324.25 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 844,140,941.79 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 834,446,579.16 |
| 减：应收利息总额 | 18,276,686.88 |
| 买卖债券差价收入 | -8,582,324.25 |

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额 | 164,726,834.55 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 163,438,351.06 |
| 减：应收利息总额 | 1,025,897.82 |
| 资产支持证券投资收益 | 262,585.67 |

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期未进行贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期无贵金属申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金不参与权证投资。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------|---------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | 10,162,385.94 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | 10,162,385.94 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | 10,162,385.94 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | 0.06 |
| 其他 | - |
| 合计 | 0.06 |

注：本基金上年度可比期间无基金赎回费、转出补偿费等其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 交易所市场交易费用 | 1,351.47 |
| 银行间市场交易费用 | 4,397.50 |
| 合计 | 5,748.97 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------|---------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 审计费用 | 39,671.58 |
| 信息披露费 | 49,588.57 |
| 银行费用 | 2,276.62 |
| 帐户维护费 | 18,600.00 |
| 其他 | - |
| 合计 | 110,136.77 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|--------------|
| 上海东方证券资产管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 基金托管人 |
| 东方证券股份有限公司（“东方证券”） | 基金管理人的股东 |

注：1、本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日 | |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 |
| 东方证券 | 373,952,357.09 | 97.86% | 155,433,400.00 | 100.00% |

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日 | |
|-------|----------------------------|--------------------|---------------------------------|------------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的比例 |
| 东方证券 | 99,700,000.00 | 100.00% | - | - |

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未发生应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月 30日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 172,980.02 | 1,379,610.59 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | - | - |

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准，本基金本报告期及上年度可比期间无应支付给销售机构的客户维护费。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 57,660.04 | 459,870.14 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
| 基金合同生效日（2015 年 10 月 26 日）持有的基金份额 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | 10,000,450.04 | 10,000,450.04 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 10,000,450.04 | 10,000,450.04 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 16.63% | 0.99% |

注：本报告期及上年度可比期间内，基金管理人未再运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

| 关联方名称 | 本期末 | | 上年度末 | |
|-------|-----------------|------------------|------------------|------------------|
| | 2017 年 6 月 30 日 | | 2016 年 12 月 31 日 | |
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 招商银行 | 0.00 | 0.0000% | 998,834,757.76 | 98.99% |

注：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日 | |
|-------|----------------------------|------------|---------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 招商银行 | 445,714.92 | 159,019.22 | 24,575,018.93 | 180,962.54 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在经营层面设立风险控制委员会，负责在董事会授权范围内的重大经营项目和创新业务的风险评估；在业务操作层面风险管理职责主要由合规与风险管理部和风险管理人員负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 20,951,700.00 | 96,870,000.00 |
| 合计 | 20,951,700.00 | 96,870,000.00 |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券包含期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票以及未有第三方机构评级的其他债券。

3、本期末未评级债券中，包含国债、同业存单 20,951,700.00 元。

6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 17,637,760.00 | 581,198,651.06 |
| AAA 以下 | 17,320,740.00 | 126,392,000.00 |
| 未评级 | - | 114,849,000.00 |
| 合计 | 34,958,500.00 | 822,439,651.06 |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券包含期限在一年以上的国债、政策性金融债、央票以及未有第三方机构评级的其他债券。。

3、本期末无未评级债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险，利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及资产支持证券等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本 期 末 201 7年 6月 30 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|------------|--------|----------|-------|-------|-----|------------|
| 资 产 | | | | | | | |
| 银 行 存 款 | 445,714.92 | - | - | - | - | - | 445,714.92 |
| 结 算 备 付 金 | 256,734.18 | - | - | - | - | - | 256,734.18 |
| 存 | 32,468.34 | - | - | - | - | - | 32,468.34 |

| | | | | | | | |
|--------------------------------------|--------------|-----------------|---------------|---------------|--|----------------|-----------------|
| 出 保 证 金 | | | | | | | |
| 交 易 性 金 融 资 产 | | - 21,495,290.00 | 20,983,850.00 | 13,431,060.00 | | - | - 55,910,200.00 |
| 买 入 返 售 金 融 资 产 | 3,000,000.00 | | | | | | 3,000,000.00 |
| 应 收 利 息 | | | | | | - 1,004,379.64 | 1,004,379.64 |
| 其 他 资 产 | | | | | | | . |
| 资 产 | 3,734,917.44 | 21,495,290.00 | 20,983,850.00 | 13,431,060.00 | | - 1,004,379.64 | 60,649,497.08 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|------------|------------|
| 总 | | | | | | | |
| 计 | | | | | | | |
| 负 | | | | | | | |
| 债 | | | | | | | |
| 应 | - | - | - | - | - | 14,880.27 | 14,880.27 |
| 付 | | | | | | | |
| 管 | | | | | | | |
| 理 | | | | | | | |
| 人 | | | | | | | |
| 报 | | | | | | | |
| 酬 | | | | | | | |
| 应 | - | - | - | - | - | 4,960.09 | 4,960.09 |
| 付 | | | | | | | |
| 托 | | | | | | | |
| 管 | | | | | | | |
| 费 | | | | | | | |
| 应 | - | - | - | - | - | 342.50 | 342.50 |
| 付 | | | | | | | |
| 交 | | | | | | | |
| 易 | | | | | | | |
| 费 | | | | | | | |
| 用 | | | | | | | |
| 其 | - | - | - | - | - | 89,260.15 | 89,260.15 |
| 他 | | | | | | | |
| 负 | | | | | | | |
| 债 | | | | | | | |
| 总 | - | - | - | - | - | 109,443.01 | 109,443.01 |

| | | | | | | | |
|-----------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|------|------------|---------------|
| 计 | | | | | | | |
| 利率敏感程度缺口 | 3,734,917.44 | 21,495,290.00 | 20,983,850.00 | 13,431,060.00 | - | 894,936.63 | 60,540,054.07 |
| 上年度末 2016年 12月 31日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 61,408,399.42 | - | - | - | - | - | 61,408,399.42 |
| 存出保证金 | 1,015.98 | - | - | - | - | - | 1,015.98 |

| | | | | | | | |
|---------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 交易性金融资产 | 40,044,000.00 | 147,201,000.00 | 171,230,626.40 | 521,898,024.66 | 38,936,000.00 | - | 919,309,651.06 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 16,525,177.72 | 16,525,177.72 |
| 资产总计 | 101,453,415.40 | 147,201,000.00 | 171,230,626.40 | 521,898,024.66 | 38,936,000.00 | 16,525,177.72 | 997,244,244.18 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 253,537.26 | 253,537.26 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 84,512.43 | 84,512.43 |

| | | | | | | | |
|---------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 2,875.00 | 2,875.00 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 200,000.00 | 200,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 540,924.69 | 540,924.69 |
| 利率敏感度缺口 | 101,453,415.40 | 147,201,000.00 | 171,230,626.40 | 521,898,024.66 | 38,936,000.00 | 15,984,253.03 | 996,703,319.49 |

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | |
|----|--|----------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析基于本基金于本报告期末的利率风险状况； | |
| | 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； | |
| | 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。 | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 |

| | 影响金额（单位：人民币元） | |
|----------|----------------------|------------------------|
| | 本期末（2017 年 6 月 30 日） | 上年度末（2016 年 12 月 31 日） |
| 上升 0.25% | -115,223.61 | -4,618,496.07 |
| 下降 0.25% | 115,223.61 | 4,618,496.07 |

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

基金承受的其他市场价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金本报告期末及上年度末未持有交易性权益类金融工具，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有交易性权益类金融工具，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

| 假设 | 1. 置信区间 95% | | |
|----|------------------------|----------------------|------------------------|
| | 2. 观察期 统计日之前的 250 个交易日 | | |
| 分析 | 风险价值 (单位：人民币元) | 本期末（2017 年 6 月 30 日） | 上年度末（2016 年 12 月 31 日） |
| | 1 天 | 26,672.91 | 921,355.00 |

| | | | |
|--|-----|-----------|--------------|
| | 1 周 | 59,642.44 | 2,060,212.42 |
|--|-----|-----------|--------------|

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 55,910,200.00 元，无属于第一层次和第三层次的余额；2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 919,309,651.06 元，无属于第一层次和第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金采用第三方估值机构根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值确定为第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日及 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 55,910,200.00 | 92.19 |
| | 其中：债券 | 55,910,200.00 | 92.19 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 3,000,000.00 | 4.95 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 702,449.10 | 1.16 |
| 7 | 其他各项资产 | 1,036,847.98 | 1.71 |
| 8 | 合计 | 60,649,497.08 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金不参与股票投资。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金不参与股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金不参与股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金不参与股票投资。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金不参与股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金不参与股票投资。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 20,951,700.00 | 34.61 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 34,958,500.00 | 57.74 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 55,910,200.00 | 92.35 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 019546 | 16 国债 18 | 120,000 | 11,986,800.00 | 19.80 |
| 2 | 019557 | 17 国债 03 | 90,000 | 8,964,900.00 | 14.81 |
| 3 | 122895 | 10 德州债 | 48,000 | 4,801,440.00 | 7.93 |
| 4 | 122864 | 11 外滩债 | 47,000 | 4,737,600.00 | 7.83 |
| 5 | 122000 | 07 长电债 | 47,000 | 4,707,050.00 | 7.78 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金不参与权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末进行国债期货投资。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末进行国债期货投资。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

本基金持有的 13 中信 01（代码：122259）发行主体中信证券股份有限公司（以下简称“公司”）2017 年 05 月 25 日公告，因公司未按照规定为司度（上海）贸易有限公司提供融资融券服务，收到中国证券监督管理委员会的《行政处罚事先告知书》（2017 第 57 号），拟决定对公司采取责令改正，给予警告，没收违法所得人民币 61,655,849.78 元，并处以人民币 308,279,248.90 元罚款的行政监管措施。

本基金对上述证券的投资决策程序符合基金合同及公司制度的相关规定，本基金管理人会对上述证券继续保持跟踪研究。

本基金持有的前十名证券中其余九名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2

本基金不参与股票投资。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 32,468.34 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,004,379.64 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,036,847.98 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金不参与股票投资。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的基 金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|---------------|------------|------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 4 | 15,035,898.44 | 59,999,450.04 | 99.76% | 144,143.73 | 0.24% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|----------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员 持有本基金 | 0.00 | 0.0000% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人 持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占 基金总份 额 比例（%） | 发起份额总数 | 发起份额占 基金总份 额 比例（%） | 发起份额承 诺持有期限 |
|-----------------|---------------|-----------------------------|---------------|-----------------------------|----------------|
| 基金管理人固有 资金 | 10,000,450.04 | 16.63 | 10,000,450.04 | 16.63 | 3年 |
| 基金管理人高级 管理人员 | | | | | |

| | | | | | |
|---------|---------------|-------|---------------|-------|-----|
| 基金经理等人员 | | | | | |
| 基金管理人股东 | | | | | |
| 其他 | | | | | |
| 合计 | 10,000,450.04 | 16.63 | 10,000,450.04 | 16.63 | 3 年 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-----------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（ 2015 年 10 月 26 日 ）基金份额总额 | 210,227,150.73 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,009,029,692.76 |
| 本报告期基金总申购份额 | 49,999,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 998,885,098.99 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 60,143,593.77 |

注：总申购份额含红利再投份额（本基金暂未开通基金转换业务）。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是立信会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元 数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|------------|------|-----------------|-----------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比 | 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | |
| | | | | | | |

| | | | 例 | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 宏信证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。本基金本报告期未发生应支付关联方的佣金。

2、交易单元的选择标准和程序：（1）选择标准：券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。（2）选择程序：基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、截至本报告期末，本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格；本公司已在深圳交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

4、本基金本报告期内租用交易单元的变更情况：新增宏信证券深圳交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|----------------|--------------|---------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东方证券 | 373,952,357.09 | 97.86% | 99,700,000.00 | 100.00% | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 宏信证券 | 8,185,601.64 | 2.14% | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|------|--------|--------|
|----|------|--------|--------|

| | | | |
|---|--|----------------------------|-----------------|
| 1 | 上海东方证券资产管理有限公司旗下基金 2016 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站 | 2017 年 1 月 3 日 |
| 2 | 东方红纯债债券型发起式证券投资基金 2016 年第 4 季度报告 | 中国证券报和公司网站 | 2017 年 1 月 3 日 |
| 3 | 东方红纯债债券型发起式证券投资基金恢复申购业务的公告 | 中国证券报和公司网站 | 2017 年 3 月 30 日 |
| 4 | 东方红纯债债券型发起式证券投资基金 2016 年年度报告 | 公司网站 | 2017 年 3 月 30 日 |
| 5 | 东方红纯债债券型发起式证券投资基金 2016 年年度报告（摘要） | 中国证券报和公司网站 | 2017 年 3 月 30 日 |
| 6 | 东方红纯债债券型发起式证券投资基金暂停申购业务的公告 | 中国证券报和公司网站 | 2017 年 4 月 15 日 |
| 7 | 东方红纯债债券型发起式证券投资基金 2017 年第 1 季度报告 | 中国证券报和公司网站 | 2017 年 4 月 21 日 |
| 8 | 东方红纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）（2017 年第 1 号） | 中国证券报和公司网站 | 2017 年 6 月 2 日 |
| 9 | 东方红纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2017 年第 1 号） | 公司网站 | 2017 年 6 月 2 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | 报告期末持有基金情况 | | |
|--|----------------|-------------------------|----------------|------|----------------|---------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20170401-20170630 | 49,999,000.00 | - | - | 49,999,000.00 | 83.13% |
| | 2 | 20170101-20170331 | 998,834,757.76 | - | 998,834,757.76 | - | 0.00% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>本基金由于存在单一投资者份额集中度较高的情况，可能存在巨额赎回的风险，增加基金管理人的流动性管理压力；基金管理人应付赎回的变现行为可能使基金资产净值受到不利影响或者产生较大波动。本基金管理人后期将审慎评估大额申购对基金份额集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，加强对基金持有人利益的保护。</p> | | | | | | | |

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红纯债债券型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《东方红纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红纯债债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红纯债债券型发起式证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人办公场所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：
www.dfham.com。

上海东方证券资产管理有限公司

2017 年 8 月 28 日